

# 汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金 2017 年半年度报告 摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：汇丰晋信基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	汇丰晋信低碳先锋股票
基金主代码	540008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 6 月 8 日
基金管理人	汇丰晋信基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	296,643,604.45 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于受益于低碳经济概念、具有持续成长潜力的上市公司，通过积极把握资本利得机会以拓展收益空间，以寻求资本的长期增值。
投资策略	<p>(1) 资产配置策略</p> <p>在投资决策中，本基金仅根据精选的各类证券的风险收益特征的相对变化，适度的调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。</p> <p>(2) 行业配置策略</p> <p>本基金所投资对象主要定位受益于低碳经济概念、具有持续成长潜力的上市公司，这些上市公司会包含很多一般意义的行业。本基金在行业选择上综合考虑多方面的因素，择优而选。行业研究员通过分析行业特征，定期提出行业投资评级和配置建议。行业比较分析师综合内、外部研究资源，对受益于低碳经济领域、行业基本面因素已出现积极变化、景气程度增加，但股票市场反应滞后的行业进行重点配置。同时，本基金将根据行业的基本面变化以及股票市场行业指数表现，实施积极的行业轮换，不断寻找新的行业投资机会，实现“资本增值”目标。</p> <p>(3) 股票资产投资策略</p> <p>本基金根据上市公司的基本面情况，首先对股票进行初步筛选，将基本面较差、投资价值较低的上市公司剔除基础股票池。在此基础上，按照本基金对于低碳经济概念的识别，我们将依靠研究团队，主要采取自下而上的选股策略，对基础股票池进行二次筛选，筛选出与低碳经济主题相关的上市公司。</p> <p>根据上市公司与低碳经济主题之间的关系，本基金将</p>

	低碳经济主题的上市公司细分为两类：1) 直接从事或受益于低碳经济主题的上市公司；2) 与低碳经济主题密切相关的上市公司。
业绩比较基准	中证环保指数*90%+同业存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，属于证券投资基金中预期风险和预计收益较高的基金产品，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇丰晋信基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	古韵	陆志俊
	联系电话	021-20376868	95559
	电子邮箱	compliance@hsbcjt.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-20376888	95559
传真		021-20376999	021-62701216

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.hsbcjt.cn
基金半年度报告备置地点	汇丰晋信基金管理有限公司：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 17 楼； 交通银行股份有限公司：上海市浦东新区银城中路 188 号。

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-37,902,322.71
本期利润	-9,101,067.50
加权平均基金份额本期利润	-0.0294
本期基金份额净值增长率	-0.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.4297

期末基金资产净值	463,647,386.09
期末基金份额净值	1.5630

注：①本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额；本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

②期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

③上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.25%	1.32%	3.33%	0.93%	2.92%	0.39%
过去三个月	-5.93%	1.50%	-3.30%	1.05%	-2.63%	0.45%
过去六个月	-0.68%	1.23%	-1.72%	0.86%	1.04%	0.37%
过去一年	-9.62%	1.16%	0.10%	0.86%	-9.72%	0.30%
过去三年	38.26%	2.26%	50.50%	1.90%	-12.24%	0.36%
自基金合同生效起至今	70.40%	1.87%	23.19%	1.54%	47.21%	0.33%

注：过去一个月指 2017 年 6 月 1 日—2017 年 6 月 30 日

过去三个月指 2017 年 4 月 1 日—2017 年 6 月 30 日

过去六个月指 2017 年 1 月 1 日—2017 年 6 月 30 日

过去一年指 2016 年 7 月 1 日—2017 年 6 月 30 日

过去三年指 2014 年 7 月 1 日—2017 年 6 月 30 日

自基金合同生效至今指 2010 年 6 月 8 日—2017 年 6 月 30 日

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2010 年 6 月 8 日至 2017 年 6 月 30 日）



注：1. 按照基金合同的约定，本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 85%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%。固定收益类证券、现金和其他资产投资比例范围为基金资产的 5%-15%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金自基金合同生效日起不超过六个月内完成建仓。截止 2010 年 12 月 8 日，本基金的各项投资比例已达到基金合同约定的比例。

2. 基金合同生效日（2010 年 6 月 8 日）起至 2015 年 3 月 31 日，本基金的业绩比较基准为“沪深 300 指数\*90% + 同业存款利率\*10%”。自 2015 年 4 月 1 日起，本基金的业绩比较基准调整为“中证环保指数\*90% + 同业存款利率（税后）\*10%”。

3. 上述基金净值增长率的计算已包含本基金所投资股票在报告期产生的股票红利收益。同期业绩比较基准收益率的计算未包含沪深 300 指数与中证环保指数成份股在报告期产生的股票红利收益。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇丰晋信基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2005 年 11 月 16 日正式成立。公司由山西信托股份有限公司与汇丰环球投资管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为 2 亿元人民币，注册地在上海。截止 2017 年 6 月 30 日，公司共管理 18 只开放式基金：汇丰晋信 2016 生命周期开放式证券投资基金（2006 年 5 月 23 日成立）、汇丰晋信龙腾混合型证券投资基金（2006 年 9 月 27 日成立）、汇丰晋信动态策略混合型证券投资基金（2007 年 4 月 9 日成立）、汇丰晋信 2026 生命周期证券投资基金（2008 年 7 月 23 日成立）、汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金

(2008 年 12 月 3 日成立)、汇丰晋信大盘股票型证券投资基金(2009 年 6 月 24 日成立)、汇丰晋信中小盘股票型证券投资基金(2009 年 12 月 11 日成立)、汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金(2010 年 6 月 8 日成立)、汇丰晋信消费红利股票型证券投资基金(2010 年 12 月 8 日成立)、汇丰晋信科技先锋股票型证券投资基金(2011 年 7 月 27 日成立)、汇丰晋信货币市场基金(2011 年 11 月 2 日成立)、汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金(2012 年 8 月 1 日成立)、汇丰晋信双核策略混合型证券投资基金(2014 年 11 月 26 日成立)、汇丰晋信新动力混合型证券投资基金(2015 年 2 月 11 日成立)、汇丰晋信智造先锋股票型证券投资基金(2015 年 9 月 30 日成立)、汇丰晋信大盘波动精选股票型证券投资基金(2016 年 3 月 11 日成立)、汇丰晋信沪港深股票型证券投资基金(2016 年 11 月 10 日成立)和汇丰晋信珠三角区域发展混合型证券投资基金(2017 年 6 月 2 日成立)。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方超	本基金基金经理	2015 年 9 月 19 日	-	9.5	曾任汇丰晋信基金管理有限公司交易员、高级交易员、交易副总监、研究员、高级研究员。现任汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金经理。

注：1. 任职日期为本基金管理人公告方超先生担任本基金基金经理的日期；

2. 证券从业年限为证券投资相关的工作经历年限。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了保护公司所管理的不同投资组合得到公平对待，充分保护基金份额持有人的合法权益，汇丰晋信基金管理有限公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运

作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》。

《汇丰晋信基金管理有限公司公平交易制度》规定：在投资管理活动中应公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。《公平交易制度》适用于投资的全过程，用以规范基金投资相关工作，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、以及投资管理过程中涉及的行为监控和业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，公司各相关部门均按照公平交易制度的规定进行投资管理活动、研究分析活动以及交易活动。同时，我公司切实履行了各项公平交易行为监控、分析评估及报告义务，并建立了相关记录。

报告期内，未发现本基金管理人存在不公平对待不同投资组合，或直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司制定了《汇丰晋信基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，加强防范不同投资组合之间可能发生的利益输送，密切监控可能会损害基金份额持有人利益的异常交易行为。

本报告期内，公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《汇丰晋信基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》的规定，对同一投资组合以及不同投资组合中的交易行为进行了监控分析，未发现异常交易行为。

报告期内未发生各投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年 A 股市场整体波动较大，在流动性日益收紧、监管处罚不断趋严以及顺利加入 MSCI 指数等众多因素的综合影响下，市场呈现了分化不断加大以及大盘化白马化龙头化的价值取向。上证综合指数上半年上涨了 2.86%，深证成指也上涨了 3.46%，但沪深 300 指数则上涨了 10.78%，上证 50 指数的涨幅更是高达 11.5%，大盘股风格倾向明显。与此同时，创业板综合指数反而下跌了 10.1%，这也是其连续第三个半年度下跌。

除了大小盘风格分化明显，市场对于低估值行业稳健增长的行业倾向也十分明显。上半年，中信家电行业指数的涨幅高达近 30，食品饮料行业指数的涨幅也有 19%，电子元器件和银行板块的涨幅也在 9% 左右，与之对应的，国防军工、传媒、计算机、纺织服装和农林牧渔五个板块的跌



幅都在 10%以上。市场投资者在风险偏好极度下降的过程中对于业绩确定性和低估值的追逐在不断提升。

本基金专注于低碳领域的中小盘成长股，因此在上半年的高估值中小盘个股被市场抛弃的过程中波动较大。但极致的风格终究会得到修正，相对于业绩稳健的大盘个股而言，中小盘个股的优势是更高的成长性，而成长一直是资本市场的核心所在。本基金目前主要资产配置在生态园林环保建筑、新能源汽车相关产业链和大数据云计算人工智能物联网等三个主要方向上，这三个方向也是当前实体经济中最具有成长性和发展潜力的，在经历前期的下跌之后，出现了一批估值与业绩成长性匹配度非常良好的优质个股，本基金将积极挖掘和持续跟踪这些优质个股，通过企业的不断成长来分享投资收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内基金净值增长率为-0.68%，同期业绩比较基准为-1.72%，本基金领先业绩比较基准 1.04%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中央政治局最近召开会议，对当前的经济形势做出了最新的分析和判断。“上半年经济运行在合理区间，主要指标好于预期。物价总体稳定。经济结构调整不断深化，新发展理念和供给侧结构性改革决策部署日益深入人心，政府和企业行为正在发生积极变化。但在充分肯定成绩的同时要清醒看到，经济运行中还存在不少矛盾和问题，要站在经济长周期和结构优化升级的角度，把握经济发展阶段性特征，保持头脑清醒和战略定力，坚定不移抓好供给侧结构性改革，妥善化解重大风险隐患，促进经济社会持续健康发展。”

上半年之所以沪深 300 指数和中小创指数出现这么大的分化，背后的很主要的驱动因素是在供给侧改革的推动下，今年以煤炭、钢铁、有色、化工为代表的大多数周期类行业公司的业绩非常靓丽，与此同时众多中小创民营企业的利润增长却举步维艰。但供给侧改革作为阶段性强力去库存去产能去杠杆的措施，势必还是会回到正常的市场措施上来，周期性行业公司的利润率也还是应该回到正常的水平上来，反应社会活跃状态的中小创企业才是未来成长的主要驱动因素。有数据显示，上半年最终消费支出对于经济增长的贡献率已经高达 63.4%，我国的经济形态已经逐渐从“生产社会”、“投资社会”走到了“消费社会”，而在满足人民群众日益增长的各种消费需求上，需要无数的中小创企业不断的创新和努力。

除了经济形势的变化之外，今年金融去杠杆和严监管的思路也对市场产生了不小的冲击。但

也需要清醒的认识到，货币的空转在给经济不断积累着资产泡沫的风险，提前处置逐渐化解比未来的集中释放毫无疑问更加有利于经济的转型和发展。金融去杠杆的目的是为了实体加杠杆，健康有序的实体经济才是一个长期稳健发展的金融市场的基础所在。当前从大类资产配置单角度和市场所处的位置而言，股票市场应该是一个对于投资者具有相对吸引力的场所，管理层之所以加强监管和处罚的力度，也是为了让市场能够以一个更加规范化和秩序化的状态来迎接更多投资者的进入。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金的基金管理人为确保及时、准确、公正、合理地进行基金份额净值计价，更好地保护基金份额持有人的合法权益，根据中国证券业协会 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会会计字[2007]21 号）、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008]38 号）的相关规定，结合本基金基金合同关于估值的约定，针对基金估值流程制订《汇丰晋信基金管理有限公司投资品种估值小组议事规则》，经公司管理层批准后正式实施。

根据《汇丰晋信基金管理有限公司投资品种估值小组议事规则》：

1. 公司特设投资品种估值小组作为公司基金估值的主要决策机关。投资品种估值小组负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策等工作。投资品种估值小组的组成人员包括：公司总经理、督察长、首席运营官、基金投资总监、基金运营总监、产品开发总监、特别项目部总监和风险控制经理以及列席投资品种估值小组会议的公司其他相关人员。上述成员均持有中国基金业从业资格，在各自专业领域具有较为丰富的行业经历和专业经验，成员之间不存在任何重大利益冲突。

2. 投资品种估值小组工作主要在以下公司相关职能部门—基金投资部、基金运营部、产品开发部和风险控制部以及其他相关部门的配合下开展工作，其中：

##### 一、基金运营部

1. 及时发现和报告估值被歪曲、有失公允情况，并召集相关人员进行讨论，提出调整方法、改进措施，报经投资品种估值小组审批同意后，执行投资品种估值小组的决定。

2. 除非产生需要更新估值政策或程序情形并经投资品种估值小组同意，应严格执行已确定的估值政策和程序。

3. 公司管理的基金采用新投资策略或投资新品种时，提请投资品种估值小组对现有估值政策

和程序的适用性进行评价，并依据评价结果进行估值。

## 二、基金投资部

基金经理及时发现和报告估值被歪曲、有失公允情况，向投资品种估值小组提出相关意见和建议，但基金经理不参与最终的估值决策。

## 三、产品开发部

产品开发部在估值模型发生重大变更时，向投资品种估值小组提出相关意见和建议。

## 四、风险控制部

根据规定组织相关部门及时披露与基金估值有关的信息；检查和监督公司关于估值各项工作的开展和落实，定期不定期向投资品种估值小组报告公司相关部门执行估值政策和程序情况（包括但不限于公司对投资品种估值时应保持估值政策和程序的一贯性），并对进一步完善估值内控工作提出意见和建议。

## 五、督察长

监督和检查公司关于估值各项工作的开展和落实，向投资品种估值小组提交对估值议案的合法合规性审核意见。

1. 投资品种估值小组定期会议每三个月召开一次；对估值模型进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况下，应及时修订本估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经过本公司管理委员会的批准后方可实施。

2. 如果基金准备采用新投资策略或投资新品种或者有其他重大或突发性相关估值事项发生时，应召开临时会议，或者投资品种估值小组成员列席参加公司风控委员会会议，通过公司风控委员会会议讨论并通过上述估值事项。

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同的要求，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金暂不进行利润分配。

## 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2017 年上半年度，基金托管人在汇丰晋信低碳先锋证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2017 年上半年度，汇丰晋信基金管理有限公司在汇丰晋信低碳先锋证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2017 年上半年度，由汇丰晋信基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关汇丰晋信低碳先锋证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	621, 552. 92	643, 250. 69

结算备付金		26,555,617.84	59,085,319.43
存出保证金		298,287.98	767,318.45
交易性金融资产	6.4.7.2	439,138,199.11	441,156,863.32
其中：股票投资		439,138,199.11	441,156,863.32
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	14,765.89	15,987.26
应收股利		-	-
应收申购款		124,082.99	124,568.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		466,752,506.73	501,793,307.99
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年6月30日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		801,004.97	32,403,508.59
应付管理人报酬		603,446.79	648,557.57
应付托管费		100,574.47	108,092.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,398,729.92	1,820,937.19
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	201,364.49	522,413.56
负债合计		3,105,120.64	35,503,509.84
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	296,643,604.45	296,310,571.66
未分配利润	6.4.7.10	167,003,781.64	169,979,226.49
所有者权益合计		463,647,386.09	466,289,798.15
负债和所有者权益总计		466,752,506.73	501,793,307.99

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5630 元，基金份额总额 296,643,604.45 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-327,988.04	-184,065,572.82
1.利息收入		289,048.68	634,767.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	276,394.04	634,767.14
债券利息收入		-	-
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融 资产收入		12,654.64	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-” 填列)		-29,651,227.92	-103,133,184.63
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-31,628,940.51	-106,360,676.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券 投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收 益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,977,712.59	3,227,491.63
3.公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.17	28,801,255.21	-82,274,697.04
4.汇兑收益(损失以 “-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-” 号填列)	6.4.7.18	232,935.99	707,541.71
<b>减：二、费用</b>		8,773,079.46	25,440,748.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,647,492.29	6,787,245.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	607,915.38	1,131,207.65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,309,122.51	17,313,633.03
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	208,549.28	208,662.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,101,067.50	-209,506,321.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,101,067.50	-209,506,321.67

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	296,310,571.66	169,979,226.49	466,289,798.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,101,067.50	-9,101,067.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	333,032.79	6,125,622.65	6,458,655.44
其中：1.基金申购款	115,288,506.60	77,513,031.11	192,801,537.71
2.基金赎回款	-114,955,473.81	-71,387,408.46	-186,342,882.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	296,643,604.45	167,003,781.64	463,647,386.09
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基	590,811,196.04	631,308,539.51	1,222,119,735.55

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-209,506,321.67	-209,506,321.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-135,597,513.85	-89,817,973.96	-225,415,487.81
其中：1.基金申购款	214,951,910.94	125,654,740.82	340,606,651.76
2.基金赎回款	-350,549,424.79	-215,472,714.78	-566,022,139.57
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	455,213,682.19	331,984,243.88	787,197,926.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>王栋</u>	<u>赵琳</u>	<u>杨洋</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]471号《关于核准汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金募集的批复》核准,由汇丰晋信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 666,375,731.65 元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)(原“毕马威华振会计师事务所有限公司”)KPMG-B(2010)CR No. 0032 验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 6 月 8 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 666,460,299.86 份基金份额,其中认购资金利息折合 84,568.21 份基金份额。本基金的基金管理人为汇丰晋信基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金基金合



同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具，其中股票投资比例为基金资产的 85%-95%，投资于低碳经济领域的股票比例占股票投资的 80%以上；权证投资比例为 0%-3%；固定收益类证券、现金和其他资产投资比例为 5%-15%；其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于 5%。根据《关于汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金变更业绩比较基准以及修改基金合同的公告》，自 2015 年 4 月 1 日起，本基金业绩比较基准由原先的“沪深 300 指数 X90%+同业存款利率 X10%”变更为：中证环保指数 X90%+同业存款利率(税后)X10%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司于 2017 年 8 月 26 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇丰晋信低碳先锋股票型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 06 月 30 日的财务状况以及 2017 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金财务报告所采用的会计政策、会计估计与上年度财务报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本报告期内，本基金无重大会计差错发生。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改

征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。自 2018 年 1 月 1 日起，对资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇丰晋信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：相关关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过股票交易。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过债券交易。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过债券回购交易。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,647,492.29	6,787,245.56
其中：支付销售机构的客户维护费	1,138,968.11	1,242,583.75

注：支付基金管理人汇丰晋信基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月	2016年1月1日至2016年6月30

	30 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	607,915.38	1,131,207.65

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行过债券(含回购)交易。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，除本基金管理人外的其他关联方均未投资本基金。

### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	621,552.92	1,799.58	626,880.54	1,947.76

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2017 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2016 年 06 月 30 日：同)。

### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期间与上年度可比期间，本基金在承销期内未参与关联方承销的证券。

## 6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.10.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估	备注

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位:股)	成本总额	值总额	
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。

其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002684	猛狮科技	2017年4月20日	重大事项	21.22	-	-	600,000	13,634,048.49	12,732,000.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌  
的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押  
的债券。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押  
的债券。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最  
低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属  
于第一层次的余额为 426,282,516.01 元，属于第二层次的余额为 12,855,683.10 元，无第三层  
次(2016 年 12 月 31 日：第一层次 432,070,879.60 元，第二层次 9,085,983.72 元，无属于第三  
层次的余额)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易  
不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期  
间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输  
入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	439,138,199.11	94.08
	其中：股票	439,138,199.11	94.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	27,177,170.76	5.82
8	其他各项资产	437,136.86	0.09
9	合计	466,752,506.73	100.00

### 7.2 期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	10,120,000.00	2.18
C	制造业	227,879,916.00	49.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,388,000.00	6.77

E	建筑业	104,030,000.00	22.44
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,219,839.62	9.11
J	金融业	187,943.49	0.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	23,312,500.00	5.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	439,138,199.11	94.71

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600116	三峡水利	2,800,000	31,388,000.00	6.77
2	300197	铁汉生态	2,000,000	26,560,000.00	5.73
3	300070	碧水源	1,250,000	23,312,500.00	5.03
4	600068	葛洲坝	2,000,000	22,480,000.00	4.85
5	002431	棕榈股份	2,000,000	22,040,000.00	4.75
6	002709	天赐材料	500,000	20,585,000.00	4.44
7	603799	华友钴业	330,000	20,057,400.00	4.33
8	002594	比亚迪	400,000	19,980,000.00	4.31
9	600884	杉杉股份	1,200,000	19,764,000.00	4.26
10	002717	岭南园林	700,000	18,760,000.00	4.05

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。



## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300197	铁汉生态	35,777,093.22	7.67
2	002431	棕榈股份	33,704,465.53	7.23
3	600110	诺德股份	32,932,398.41	7.06
4	002190	成飞集成	32,904,337.87	7.06
5	603799	华友钴业	31,932,803.90	6.85
6	002259	升达林业	31,658,089.27	6.79
7	600884	杉杉股份	27,079,048.92	5.81
8	600068	葛洲坝	27,025,347.00	5.80
9	300073	当升科技	26,246,713.72	5.63
10	300070	碧水源	25,246,494.53	5.41
11	600236	桂冠电力	24,583,559.91	5.27
12	603601	再升科技	22,959,245.25	4.92
13	600522	中天科技	22,188,177.07	4.76
14	600803	新奥股份	22,034,950.30	4.73
15	002108	沧州明珠	21,303,415.00	4.57
16	000928	中钢国际	21,279,573.39	4.56
17	601766	中国中车	21,001,574.23	4.50
18	002594	比亚迪	19,969,340.08	4.28
19	002709	天赐材料	19,889,942.76	4.27
20	002460	赣锋锂业	19,048,766.24	4.09
21	002717	岭南园林	18,872,380.97	4.05
22	603019	中科曙光	18,261,454.61	3.92
23	600217	中再资环	18,128,634.30	3.89
24	600416	湘电股份	17,121,804.44	3.67
25	603126	中材节能	16,962,448.53	3.64
26	000777	中核科技	16,807,634.04	3.60
27	601669	中国电建	16,609,532.36	3.56
28	002055	得润电子	16,271,803.75	3.49
29	002200	云投生态	15,961,442.22	3.42
30	002368	太极股份	15,825,384.70	3.39

31	000957	中通客车	15,824,200.69	3.39
32	300166	东方国信	15,571,073.21	3.34
33	002405	四维图新	15,488,238.48	3.32
34	000970	中科三环	15,461,865.43	3.32
35	600021	上海电力	15,232,179.00	3.27
36	002080	中材科技	14,878,255.42	3.19
37	002364	中恒电气	14,697,513.35	3.15
38	300349	金卡智能	14,675,267.13	3.15
39	600480	凌云股份	14,432,698.93	3.10
40	600970	中材国际	14,347,836.50	3.08
41	300014	亿纬锂能	14,229,388.92	3.05
42	601857	中国石油	13,858,707.50	2.97
43	603993	洛阳钼业	13,844,677.00	2.97
44	300037	新宙邦	13,697,156.35	2.94
45	000800	一汽轿车	13,654,349.04	2.93
46	002684	猛狮科技	13,634,048.49	2.92
47	600184	光电股份	12,808,662.25	2.75
48	600651	飞乐音响	12,805,437.02	2.75
49	300362	天翔环境	12,668,379.28	2.72
50	600066	宇通客车	12,617,750.78	2.71
51	600841	上柴股份	12,555,456.00	2.69
52	600116	三峡水利	12,507,914.00	2.68
53	000559	万向钱潮	12,309,084.87	2.64
54	002139	拓邦股份	12,223,738.62	2.62
55	002230	科大讯飞	12,112,280.21	2.60
56	600023	浙能电力	12,069,222.10	2.59
57	600642	申能股份	12,030,000.00	2.58
58	600487	亨通光电	11,915,558.97	2.56
59	601989	中国重工	11,823,727.00	2.54
60	601158	重庆水务	11,694,782.43	2.51
61	002221	东华能源	11,680,061.11	2.50
62	600176	中国巨石	11,632,945.00	2.49
63	002573	清新环境	11,581,826.19	2.48
64	600516	方大炭素	11,485,991.30	2.46
65	600995	文山电力	11,481,568.00	2.46
66	000839	中信国安	11,285,763.52	2.42

67	000669	金鸿能源	10,867,168.15	2.33
68	002792	通宇通讯	10,481,069.91	2.25
69	000069	华侨城 A	10,479,586.48	2.25
70	600027	华电国际	10,458,253.00	2.24
71	600886	国投电力	10,414,349.80	2.23
72	600089	特变电工	10,320,428.89	2.21
73	300222	科大智能	10,063,218.53	2.16
74	002218	拓日新能	10,016,722.04	2.15
75	300473	德尔股份	9,688,456.00	2.08
76	002245	澳洋顺昌	9,578,103.69	2.05

注：本表“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600110	诺德股份	51,993,876.66	11.15
2	300014	亿纬锂能	36,753,723.50	7.88
3	000957	中通客车	33,380,528.59	7.16
4	002466	天齐锂业	31,943,866.69	6.85
5	002108	沧州明珠	31,411,735.19	6.74
6	002190	成飞集成	29,736,059.02	6.38
7	002460	赣锋锂业	29,624,460.82	6.35
8	600803	新奥股份	29,562,766.25	6.34
9	600416	湘电股份	28,685,779.24	6.15
10	002259	升达林业	25,260,696.68	5.42
11	603799	华友钴业	25,026,129.54	5.37
12	300073	当升科技	24,782,300.45	5.31
13	300037	新宙邦	23,815,341.20	5.11
14	000777	中核科技	23,725,680.15	5.09
15	600236	桂冠电力	23,650,530.70	5.07
16	600686	金龙汽车	21,676,447.58	4.65
17	601766	中国中车	21,297,092.76	4.57
18	002245	澳洋顺昌	20,852,220.20	4.47
19	300064	豫金刚石	20,161,738.00	4.32
20	000400	许继电气	19,858,591.55	4.26

21	600116	三峡水利	19,085,461.04	4.09
22	600480	凌云股份	18,408,647.00	3.95
23	600217	中再资环	18,299,225.46	3.92
24	603126	中材节能	18,032,303.00	3.87
25	002341	新纶科技	17,220,769.82	3.69
26	002080	中材科技	16,219,306.10	3.48
27	000826	启迪桑德	15,867,512.68	3.40
28	601669	中国电建	15,598,773.00	3.35
29	600021	上海电力	15,375,255.30	3.30
30	002055	得润电子	14,735,082.09	3.16
31	600500	中化国际	14,696,996.00	3.15
32	002230	科大讯飞	14,591,912.80	3.13
33	002200	云投生态	14,358,743.00	3.08
34	601857	中国石油	14,223,040.89	3.05
35	600522	中天科技	14,141,368.73	3.03
36	601777	力帆股份	13,870,888.00	2.97
37	000800	一汽轿车	13,812,499.88	2.96
38	002709	天赐材料	13,686,859.05	2.94
39	600066	宇通客车	12,751,494.92	2.73
40	300362	天翔环境	12,656,570.56	2.71
41	600176	中国巨石	12,652,247.67	2.71
42	600516	方大炭素	12,616,203.41	2.71
43	000970	中科三环	12,582,992.88	2.70
44	600023	浙能电力	12,473,608.96	2.68
45	300349	金卡智能	12,440,986.50	2.67
46	002431	棕榈股份	12,431,289.85	2.67
47	601989	中国重工	12,351,988.76	2.65
48	000980	众泰汽车	12,195,630.01	2.62
49	600642	申能股份	12,119,627.21	2.60
50	601158	重庆水务	11,825,482.00	2.54
51	600787	中储股份	11,763,075.65	2.52
52	600841	上柴股份	11,759,072.19	2.52
53	601985	中国核电	11,500,000.00	2.47
54	000559	万向钱潮	11,192,174.48	2.40
55	600184	光电股份	11,178,057.48	2.40
56	000069	华侨城A	11,096,057.84	2.38
57	002364	中恒电气	11,028,519.30	2.37
58	600886	国投电力	11,010,076.07	2.36

59	600995	文山电力	10,896,803.00	2.34
60	002221	东华能源	10,821,401.00	2.32
61	002418	康盛股份	10,614,739.00	2.28
62	600651	飞乐音响	10,507,208.18	2.25
63	002533	金杯电工	10,272,194.85	2.20
64	600089	特变电工	10,263,380.00	2.20
65	600027	华电国际	10,188,003.99	2.18
66	000839	中信国安	10,101,368.86	2.17
67	002089	新海宜	9,882,146.66	2.12
68	300473	德尔股份	9,870,131.00	2.12
69	600475	华光股份	9,474,542.16	2.03

注：本表“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,419,460,601.09
卖出股票收入（成交）总额	1,418,651,580.00

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明

细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证 券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	298,287.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,765.89
5	应收申购款	124,082.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	437,136.86

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中，市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
22,886	12,961.79	74,132,318.46	24.99%	222,511,285.99	75.01%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	16,620.94	0.0056%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年6月8日）基金份额总额	666,460,299.86
本报告期期初基金份额总额	296,310,571.66
本报告期基金总申购份额	115,288,506.60
减：本报告期基金总赎回份额	114,955,473.81
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	296,643,604.45

注：此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

经公司董事会审议批准，并报中国证券投资基金业协会备案，本公司于2017年1月12日聘任曹庆先生为公司副总经理并已正式对外发布公告。



本报告期内，本公司高级管理人员未发生不能正常履行职责的情况。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人和基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

经汇丰晋信基金管理有限公司董事会审议通过，并经基金托管人同意，本基金于 2015 年 4 月 18 日将其审计的会计师事务所由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）更换为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），并报中国证券监督管理委员会备案。本基金本报告期内未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

本报告期内托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	2	442,412,901.62	15.61%	412,019.95	15.61%	-
中信证券	2	326,517,137.36	11.52%	304,085.91	11.52%	-
中泰证券	2	319,369,158.18	11.27%	297,428.71	11.27%	-
安信证券	2	288,008,025.63	10.16%	268,222.58	10.16%	-

兴业证券	1	229,804,909.29	8.11%	214,015.27	8.11%	-
西南证券	1	209,702,816.55	7.40%	195,294.53	7.40%	-
光大证券	1	178,738,516.93	6.31%	166,459.24	6.31%	-
招商证券	2	169,260,324.16	5.97%	157,631.95	5.97%	-
海通证券	1	162,766,823.85	5.74%	151,584.31	5.74%	-
华泰证券	2	151,141,732.32	5.33%	140,758.71	5.33%	-
东兴证券	1	106,089,262.20	3.74%	98,801.50	3.74%	-
川财证券	1	87,643,712.66	3.09%	81,623.11	3.09%	-
中金公司	1	73,283,332.63	2.59%	68,247.94	2.59%	-
申万宏源	1	71,984,250.51	2.54%	67,038.24	2.54%	-
银河证券	1	17,035,797.74	0.60%	15,865.72	0.60%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
合计	29	2,833,758,702.00	100.00%	2,639,077.67	100.00%	-

1、报告期内增加的交易单元为：中泰证券、申万宏源

2、专用交易单元的选择标准和程序

1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

- a. 实力雄厚，信誉良好；
- b. 公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好，过去三年未有任何违规经营记录；
- c. 公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；
- d. 公司内部管理规范，研究流程严谨清晰，能满足基金操作的高度保密要求；
- e. 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，能及时为本基金提供准确全面的信息资讯服务。

2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人定期对证券公司服务质量从以下几方面进行考核，并根据考核结果选择交易单元：

- a. 研究报告的数量和质量；
- b. 提供研究服务的主动性；
- c. 资讯提供的及时性及便利性；
- d. 其他可评价的考核标准。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	15,000,000.00	17.86%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	69,000,000.00	82.14%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	84,000,000.00	100.00%	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

汇丰晋信基金管理有限公司  
2017 年 8 月 26 日